



【2024-09-27】

 中国人民银行今日进行 2780 亿元 14 天期逆回购操作，中标利率为 1.65%，前次为 1.85%。今日有 5719 亿元逆回购到期。资金面整体偏紧。7d repo fixing: 1.90%，与上一交易日下降 15bp，3m shibor fixing: 1.8350%，与上一交易日下降 0.1bp。

 Repo 端，5y repo 早盘成交在 1.705%附近，后快速震荡上行，成交在 1.705%-1.785%区间附近，午盘报收 78.5/78。中午回来，5y repo 先下行成交到 1.76%附近，后又震荡上行，成交在 1.76%-1.8275%区间附近，报收 82.5/81.5。1y repo 全天震荡成交在 1.5925%-1.6275%区间附近，报收 63/62.5。其他期限，2y repo 成交在 1.58%附近。 曲线方面，2x5y repo 成交在 14-16bp 区间附近，1x5y repo 成交在 11bp-19.75bp 区间附近，曲线走陡，报收 19.5/18.5。

 Shibor 端今日成交清淡，1y shibor 报收 74.75/68.25。5y shibor 报收 90.5/86.5。基差方面，1y basis 报收 12.25/05.25，5y basis 报收 8/5。

 其他方面，报价寥寥，未闻成交。

Data Source: Shanghai CFETS-NEX / ICAP HK

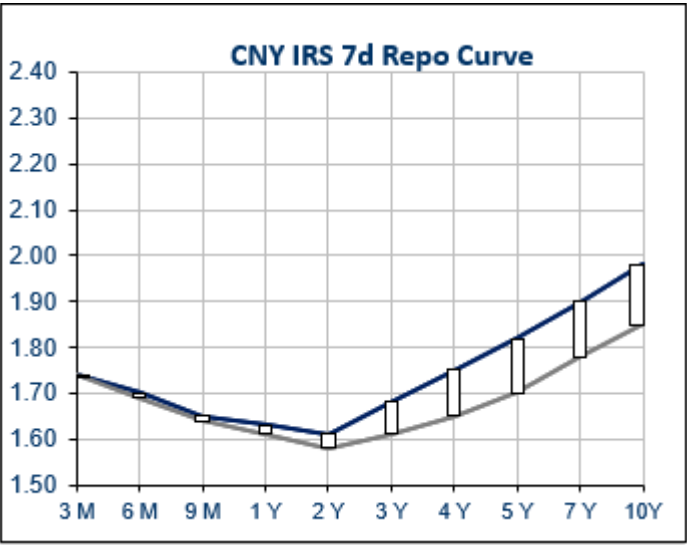
2024/9/27 星期五

ONSHORE IRS			Shanghai CFETS-NEX International Money Broking Co., Ltd												OFFSHORE IRS		
Qtrly/7d Repo			Qtrly/3m SHIBOR						Annually/O-N SHIBOR			Annually/1Y DEPO			Qtrly/7D REPO		
ACT/365(F)			A/365 (F) A/360(F)						A/365 (F) A/360(F)			A/365 (F) A/360(F)			A/365		
Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp	Tenor	Mid	Δbp
3 M	1. 74	-				3 M	1. 6	-15									
6 M	1. 7	1	6 M	1. 84	4	6 M	1. 6	-15									
9 M	1. 65	1	9 M	1. 74	4	9 M	1. 6	-15									
1 Y	1. 63	2	1 Y	1. 72	4	1 Y	1. 6	-15							1Y	1. 61	1
2 Y	1. 61	3	2 Y	1. 74	8	2 Y	1. 55	-	2 Y	1. 65	-	2Y	1. 6	4			
3 Y	1. 68	7	3 Y	1. 81	15	3 Y	1. 6	-15	3 Y	1. 77	-	3Y	1. 67	8			
4 Y	1. 75	10	4 Y	1. 81	12				4 Y	1. 8	-	4Y	1. 74	10			
5 Y	1. 82	12	5 Y	1. 9	14				5 Y	1. 8	-	5Y	1. 78	12			
7 Y	1. 9	12	7 Y	1. 96	17				7 Y	1. 8	-						
10Y	1. 98	13	10Y	2. 04	18				10Y	1. 8	-						
7D REPO	1.90	-15.00	3M Shibor	1. 835	-0.10	O-N Shibor	1.401	-20.70	1Y DEPO	1.50							

SPREAD	REPO		SHIBOR		BASIS	SHIBOR-REPO	
3M*6M	-4	1			Tenor	Mid	Δbp
6M*9M	-5	-	-10	-			
9M*1Y	-2	1	-2	-	6M	14	3
1*2Y	-2	1	2	4	9M	9	3
1*3Y	5	5	9	11	1Y	9	2
1*4Y	12	8	9	8	2Y	13	5
1*5Y	19	10	18	10	3Y	13	8
2*3Y	7	4	7	7	4Y	6	2
2*4Y	14	7	7	4	5Y	8	2
2*5Y	21	9	16	6			
3*4Y	7	3	0	-3			
3*5Y	14	5	9	-1			
4*5Y	7	2	9	2			
5*7Y	8	-	6	3			
5*10Y	16	1	14	4			

1Y LPR	6M	9M	1Y	2Y	3Y	4Y	5Y
昨日	26	21	17	12	10	9	8
今日	26	21	17	12	10	9	8

Bond Swap	230022/5y repo	230018/5y repo	230208/5y repo	230215/5y repo
昨日	1	37	8	45
今日	-4	36	3	43



联系人: Ruby Wu
邮箱: xiangling.bu@cfets-nex.com.cn

扫描二维码 轻松接收文字版收盘日报及更多资讯



免责声明:
以上所述及附带的信息 (以下简称“信息”) 仅用以提供信息, 且为保密的和/或者专用的信息, 其知识产归属于上海国际货币经纪有限责任公司 (以下简称“上海国际货币”) 或第三方。“信息”不能也不应被解释为任何金融工具、投资建议或任何交易策略相关的推介、定价、建议或请求。“信息”不可作为决策依据, 也不保证其完整性、及时性或准确性等要求, 且可未经通知而进行修改。所有陈述和保证均按明确免责声明。

WWW.CFETS-NEX.COM.CN